

鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资
基金
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鑫元中证 1000 指数增强发起式
基金主代码	017190
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 28 日
报告期末基金份额总额	90,189,888.93 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，追求超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，综合分析比较不同金融资产的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差

	异带来的特有风险。	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	017190	017191
报告期末下属分级基金的份额总额	43,897,288.92 份	46,292,600.01 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
1. 本期已实现收益	-2,090,403.38	-2,328,387.88
2. 本期利润	-1,472,069.64	-1,652,503.99
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0339	-0.0350
4. 期末基金资产净值	42,794,327.51	44,931,564.64
5. 期末基金份额净值	0.9749	0.9706

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元中证 1000 指数增强发起式 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.42%	0.91%	-2.98%	0.98%	-0.44%	-0.07%
过去六个月	-9.60%	0.84%	-10.28%	0.95%	0.68%	-0.11%
过去一年	-2.62%	0.79%	-5.91%	0.90%	3.29%	-0.11%
自基金合同	-2.51%	0.75%	-9.07%	0.90%	6.56%	-0.15%

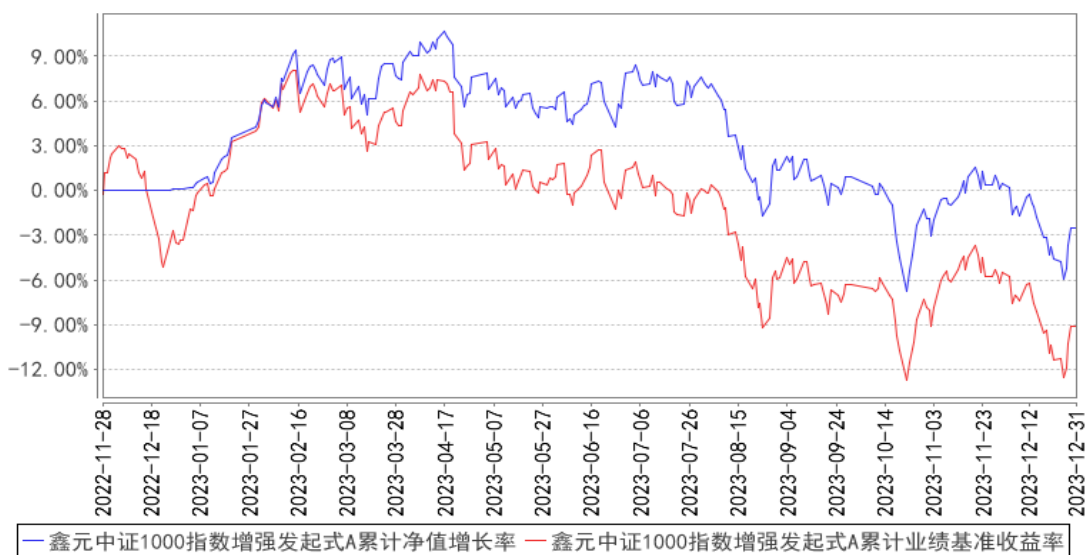
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

鑫元中证 1000 指数增强发起式 C

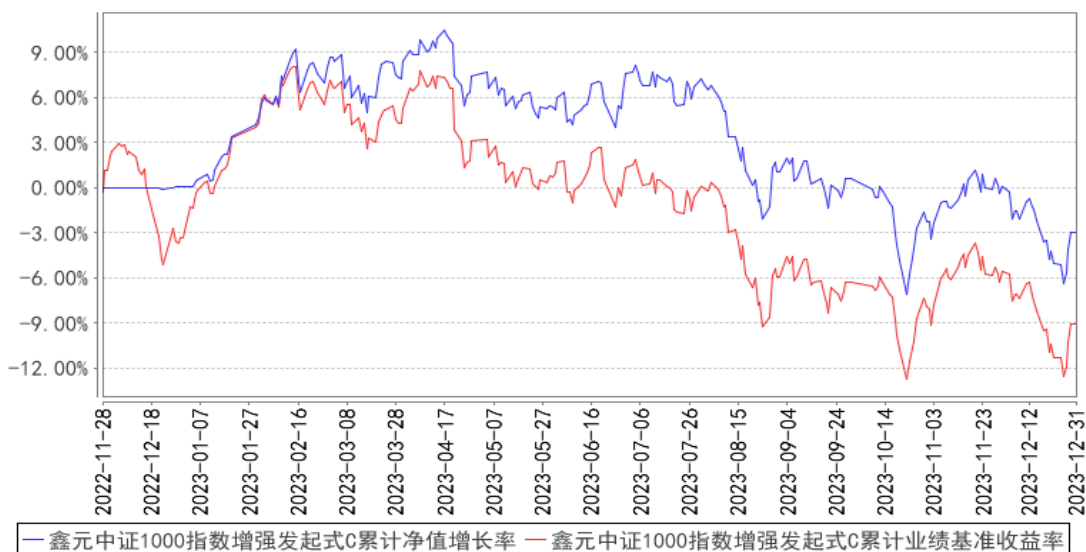
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.52%	0.91%	-2.98%	0.98%	-0.54%	-0.07%
过去六个月	-9.79%	0.84%	-10.28%	0.95%	0.49%	-0.11%
过去一年	-3.01%	0.79%	-5.91%	0.90%	2.90%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	-2.94%	0.75%	-9.07%	0.90%	6.13%	-0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鑫元中证1000指数增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鑫元中证1000指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同生效日为 2022 年 11 月 28 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宇涛	本基金的基金经理	2022 年 11 月 28 日	-	8 年	学历：工学博士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任申万菱信基金管理有限公司助理金融工程师、太平基金管理有限公司量化分析师、华宸未来基金管理有限公司投资经理。2021 年 6 月加入鑫元基金，历任权益投资经理，现任基金经理。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金的基金经理。

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易流程的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现违反公平交易要求的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及投资管理权限相关、公平交易相关、异常交易监控相关的公司制度，对本基金的异常交易行为进行监督检查。

报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度 A 股各宽基指数延续第三季度的跌势，其中，沪深 300 下跌 7.00%，中证 1000 下跌 3.15%，创业板指下跌 5.62%。从风格上看，小盘风格相对抗跌，与宏观经济关系更密切的大市值股票跌幅更大。具体到组合操作方面，我们严格按照量化选股模型运作，并不断挖掘表现较好的新因子，持续优化选股模型。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鑫元中证 1000 指数增强发起式 A 基金份额净值为 0.9749 元，本报告期基金

份额净值增长率为-3.42%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。截至本报告期末鑫元中证 1000 指数增强发起式 C 基金份额净值为 0.9706 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.52%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	80,972,116.32	91.99
	其中：股票	80,972,116.32	91.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,825,117.81	5.48
	其中：债券	4,825,117.81	5.48
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,200,001.20	1.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	760,657.02	0.86
8	其他资产	268,766.30	0.31
9	合计	88,026,658.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,492,125.00	1.70
C	制造业	47,146,913.00	53.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,424,598.00	1.62
E	建筑业	2,192,190.00	2.50
F	批发和零售业	3,593,765.00	4.10
G	交通运输、仓储和邮政业	2,822,129.76	3.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,711,842.20	7.65

J	金融业	1,235,455.00	1.41
K	房地产业	2,712,175.00	3.09
L	租赁和商务服务业	579,065.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	723,199.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	796,023.00	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	670,924.00	0.76
R	文化、体育和娱乐业	1,860,679.00	2.12
S	综合	375,615.00	0.43
	合计	74,336,697.96	84.74

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,972,688.36	5.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	339,301.00	0.39
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	98,987.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	171,969.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	607,237.00	0.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	445,236.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,635,418.36	7.56

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600710	苏美达	140,400	995,436.00	1.13
2	688100	威胜信息	29,925	865,431.00	0.99
3	002946	新乳业	62,300	715,204.00	0.82
4	002130	沃尔核材	94,200	711,210.00	0.81
5	600007	中国国贸	34,700	672,486.00	0.77
6	603556	海兴电力	22,400	650,272.00	0.74
7	002461	珠江啤酒	80,900	639,110.00	0.73
8	603871	嘉友国际	40,216	637,825.76	0.73
9	002163	海南发展	70,200	637,416.00	0.73
10	000567	海德股份	58,700	623,981.00	0.71

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300870	欧陆通	3,400	150,518.00	0.17
2	300758	七彩化学	13,600	137,496.00	0.16
3	300715	凯伦股份	11,700	136,422.00	0.16
4	300161	华中数控	3,800	136,420.00	0.16
5	603916	苏博特	13,200	134,508.00	0.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,825,117.81	5.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,825,117.81	5.50

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	019709	23 国债 16	48,000	4,825,117.81	5.50
---	--------	----------	--------	--------------	------

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/ 卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IM2401	IM2401	1	1,177,600.00	-27,440.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-27,440.00
股指期货投资本期收益（元）					-37,621.27
股指期货投资本期公允价值变动（元）					11,893.33

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资主要以多头仓位替代策略为主，获取基差收敛和现金管理的超额收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	141,312.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	127,454.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	268,766.30

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元中证 1000 指数增强 发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强 发起式 C
报告期期初基金份额总额	42,984,998.32	49,043,375.05
报告期期间基金总申购份额	2,753,420.95	2,877,243.62
减：报告期期间基金总赎回份额	1,841,130.35	5,628,018.66
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	43,897,288.92	46,292,600.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,666.83
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,666.83
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	11.0896

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截止本报告期末，本基金管理人持有本基金 10,001,666.83 份。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人 固有资金	10,001,666.83	11.0896	10,001,666.83	11.0896	3 年
基金管理人 高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等 人员	-	-	-	-	-
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,666.83	11.0896	10,001,666.83	11.0896	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2024 年 1 月 22 日